

STATISTICA ECONOMICA

Docente/i: CHIRICO PAOLO
Settore: SECS-S/03
CFU: 9
Sede: TORINO

PROGRAMMA D'ESAME A.A.: 2011-2012

Obiettivi

La conoscenza delle metodologie statistiche per l'analisi della dinamica dei fenomeni economici nel tempo (serie storiche, indici temporali) e nello spazio (indici territoriali, indici di concentrazione).

Verranno anche studiati alcuni metodi previsionali ricorrenti in ambito economico e si considereranno alcuni criteri di valutazione delle previsioni. Nell'ultima parte del corso, tali tecniche vengono viste come strumenti per l'analisi tecnica dei mercati finanziari.

Risultati dell'apprendimento

Programma

1. I numeri indici:
 - a. indici semplici,
 - b. indici composti (Laspeyres, Paasche, Fisher, Divisia),
 - c. l'inflazione,
 - d. indici di comparazione territoriale: tassi di cambio nominali e tassi di cambio reali (comprensivi del diverso potere d'acquisto)
2. Analisi Classica delle Serie Storiche:
 - a. il trend di lungo periodo (teoria dell'interpolazione)
 - b. il ciclo-trend, (teoria delle medie-mobili)
 - c. la stagionalità (diverse tecniche di destagionalizzazione)
 - d. l'analisi dei residui
3. La concentrazione:
 - a. la curva di Lorenz
 - b. il rapporto di concentrazione di Gini
 - c. altri indici di concentrazione
4. I modelli previsionali:
 - a. l'Exponential Smoothing
 - b. i modelli di Holt-Winters
 - c. criteri di valutazione delle previsioni
5. I modelli Autoregressivi
 - a. processi stocastici stazionari
 - b. processi e modelli Autoregressivi
 - c. previsioni con i modelli autoregressivi

Testi Consigliati

- Dispensa a cura del docente in Materiale Didattico
- Di Fonzo T., Lisi F., Serie Storiche Economiche. Carocci editore

Modalità Didattiche

Lezioni in aula con esercitazioni in aula multimediale.

Per i frequentanti le dispense e le lezioni dovrebbero essere sufficienti alla preparazione dell'esame. Per i non frequentanti potrebbe essere necessaria l'integrazione con i testi consigliati.

Modalità di Esame

Esame scritto con esercizi di calcolo e domande teoriche

Note

Ai fini di una buona comprensione degli argomenti trattati, è essenziale aver superato un esame base di statistica.

Documento generato il 18.06.2011 - Per gli aggiornamenti si consiglia di consultare il portale di Facoltà <http://www.scipol.unito.it>